

## Atualização de Credenciamento de Instituições Financeiras

Em conformidade com a Portaria MPS/GM nº 519, de 24 de Agosto de 2011 (alterada pela Portaria nº 440, de 09 de Outubro de 2013) e alterações posteriores.

Esclarecemos que o preenchimento deste formulário e demais anexos, em hipótese alguma, representa garantia ou compromisso de alocação de recursos na instituição, uma vez que este processo refere-se a uma apresentação da instituição junto ao instituto.

### I - IDENTIFICAÇÃO DO RPPS

Nome: FUNDO PREV SOCIAL MUN OLINDA

CNPJ: 10.554.276/0001-75

Endereço: AV SANTOS DUMONT

Cidade: MUNICÍPIO DE OLINDA      UF: PE      CEP: 53.010-903

### II - CLASSIFICAÇÃO DA INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

( ) ADMINISTRADOR    ( ) GESTOR    ( x ) ADMINISTRADOR/GESTOR    ( ) AGENTE AUTÔNOMO  
( ) DISTRIBUIDOR

### III – IDENTIFICAÇÃO DA INSTITUIÇÃO

Razão Social: Itaú Unibanco S.A.

CNPJ: 60.701.190/0001-04

Endereço: Itaú Asset Management: Av. Faria Lima 3500 – 4º andar

Cidade: São Paulo      UF: SP      CEP: 04538-132

Telefone: (11) 3631-2668 / (11) 3631-2592 / (11) 3631-2555

Web site: [www.itaubank.com.br](http://www.itaubank.com.br)

### Contatos

1 - Nome: Chrystie Lombardi

Telefone: (11) 3631-2617

E-mail: [chrystie.lombardi@itau-unibanco.com.br](mailto:chrystie.lombardi@itau-unibanco.com.br)

2 - Nome: Tiago Bezerra Patu.

Telefone: 81 981696952

E-mail: [tiago.patu@itau-unibanco.com.br](mailto:tiago.patu@itau-unibanco.com.br)

#### IV – DOCUMENTAÇÃO LEGAL

Instituição Financeira constituída conforme Estatuto Social emitido em 31/03/2015. Entidade autorizada a exercer a atividade de Administração de Carteiras, conforme Ato Declaratório/CVM/SIN/Nº 990, de 06/07/1989, pela CVM.

Atestado de Regularidade:

( x ) Fiscal Municipal - Vencimento em 26/02/2019

( x ) Fiscal Estadual - Vencimento em 29/01/2019;

( x ) Fiscal Federal e Previdenciário - Vencimento em 05/02/2019;

( x ) FGTS - Vencimento em 15/01/2019.

#### V – INFORMAÇÕES GERAIS

Patrimônio sob Gestão Nacional: R\$ 600,5 Bi

Patrimônio sob Gestão RPPS: R\$ 4,6 Bi

Patrimônio sob Gestão Global: R\$ 657,4 Bi

Data base: out/2017

**Atualizar relatório de avaliação por agência de *Rating* (anexar relatório mais recente).**

#### VI – RECURSOS HUMANOS

Atualização na quantidade de profissionais que compõem a equipe de administração, gestão e risco? Caso afirmativo anexar currículos dos profissionais.

Fernando Beyruti passou a integrar o quadro da Itaú Asset Management como Co-Head no final de 2015.

**Fernando Beyruti**

*Co-Head da Itaú Asset Management*

Fernando Beyruti possui 17 anos de experiência no mercado financeiro, atuando em diversas áreas como: Private Banking, Asset Management e Corretoras. Dentro desses 17 anos de experiência, 13 foram dedicados ao Banco Itaú, onde trabalhou nas áreas de investimentos e vendas. Ele foi um dos responsáveis pela Itaú Wealth Management (IGGP), e Head da área de Novos Negócios do Itaú Private Bank, antes de se tornar Diretor de Clientes Institucionais e Securities Services.

Atualmente é responsável pela distribuição, Internacional Asset Management, suporte às empresas, Fundo de Fundos e da Comissão sobre Gestão de Ativos Financeiros (CAAF), juntamente com o Departamento de Inovação. Beyruti também, é membro do programa de parceiro associado do Itaú. É graduado em Administração de Empresas pela Universidade Mackenzie e possui MBA em Finanças pelo IBMEC São Paulo. Além disso, foi certificado com a Gestão Estratégica Avançada do IMD, International Management (CIM) da Rotman School of Business, em Toronto, e como um Certified Financial Planner (CFP).



## VII – INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Atualize a descrição da estrutura de análise econômica e de pesquisa da empresa. Utiliza *research* próprio ou de terceiros? Em que proporções?

A Itaú Asset Management investe significativamente em pesquisa. As mesas de gestão contam com as áreas de pesquisas fundamentalistas, econômica, quantitativa e de crédito.

A Itaú Asset Management possui equipe que cobre a América Latina, EUA, Europa e Ásia com foco em China e Japão.

A pesquisa de crédito está inserida na mesa de fundos de crédito e possui parte da equipe focada em análise e gestão de crédito Brasil e Latam.

A pesquisa quantitativa provê suporte às mesas de gestão para modelagem de estratégias mais sofisticadas. A área também atua no desenvolvimento de tecnologias de Portfolio Solutions.

A análise de renda variável está segregada em dois grupos principais: estratégias ativas e estratégias de retorno absoluto.

A Itaú Asset Management utiliza modelos próprios em sua grande maioria, mas também utilizamos serviços de consultores políticos e econômicos, especializados nos mercados doméstico e internacional. A importância da utilização destas fontes está em:

- Informações mais detalhadas e globais para fins comparativos;
- Sermos formadores de opinião;
- Monitoramento de consenso de mercado.

Descreva a estrutura de gerenciamento de riscos da empresa.

A Superintendência de Gestão de Riscos Asset (SGRA) tem por objetivo implementar políticas de risco e difundir a cultura de análise de riscos financeiros nas unidades de negócio da WMS (Wealth Management & Services). A SGRA, subordinada à Diretoria de Gestão de Riscos e Planejamento, é uma área independente das unidades de negócio e é responsável pelo desenvolvimento e implementação dos modelos de risco de mercado, liquidez, precificação e *suitability* e pela análise, controle e monitoramento do risco dos produtos oferecidos pela Itaú Asset Management.

Descrição de regras e controles – Risco de Crédito

O mandato do fundo estabelece um percentual máximo de alocação do PL do Fundo em emissores de crédito privado de acordo com o nível de exposição a risco de crédito de cada emissor. Tais limites são monitorados diariamente pela diretoria de gestão de riscos.

Os níveis de exposição a risco de crédito da Itaú Asset Management, de forma consolidada, são definidos em Comitês de Crédito que contam com a participação dos principais executivos das áreas ligadas à gestão de recursos e controlados pela diretoria de gestão de riscos.

As decisões sobre quais ativos serão analisados são realizadas em um Comitê de Investimento, do qual participam analistas e gestores. A decisão é colegiada. Definido que a operação é interessante, o analista responsável fará a análise retrospectiva e prospectiva do crédito.

As decisões sobre o risco de crédito são tomadas em um Comitê de Crédito. Existe uma Política de Alçadas bem definida e ratificada pela área de risco da Itaú Unibanco Holding.

Descrição de regras e controles – Risco de Liquidez



O Gerenciamento de Risco de Liquidez da carteira do fundo busca mitigar os riscos, de forma que sua liquidez seja compatível com os prazos previstos no regulamento para pagamento dos pedidos de resgate e o cumprimento das obrigações do fundo. Para isso, efetuamos o controle da liquidez dos diferentes ativos financeiros do fundo, através de Índice de Liquidez calculado a partir de metodologia própria definida na política de risco de liquidez.

No caso de fundos de renda fixa, procura-se manter parte do portfólio em títulos do governo federal que podem, quando necessário, ser revendidos no mercado. Estas aplicações são diversificadas para várias datas de vencimento de forma a permitir liquidez em nível suficiente para os resgates que sejam realizados.

No caso de fundos de ações, a liquidez diária é um dos fatores considerados na seleção dos ativos que compõem a carteira. Em geral, os fundos de ações podem ter até 5% de sua carteira em títulos públicos de alta liquidez, como lastro de posições não alavancadas em mercados futuros.

No caso de fundos que perseguem um benchmark, parte do patrimônio é investido em futuros com trava em renda fixa de forma a reproduzir sinteticamente o “ativo base” com o objetivo de, se necessário, gerar caixa para os resgates.

É válido ressaltar que o controle de risco é baseado no limite global do Fundo ou Carteira e é realizado com frequência diária. Além disso, as mesas fazem o controle e os ajustes gerenciais das posições, baseados na exposição de risco que desejam ter em cada um dos books.

#### Descrição de regras e controles – Risco de Mercado

##### **Comitê de Risco de Mercado**

O Comitê de Risco de Mercado reúne-se trimestralmente sob a coordenação da SGRA (Superintendência Geral de Riscos da Asset). Tem por finalidade discutir e sugerir cenários de stress para o Comitê de Investimento, além de apresentar e discutir modelagens e controles de risco de mercado.

Participam do Comitê os responsáveis pelas áreas de Risco, Suporte Gerencial e Gestão.

#### Descrição de regras e controles – Risco Operacional

A política de gestão de falhas operacionais é acompanhada corporativamente, sendo que o Comitê de Riscos Operacionais do Itaú delibera como tratar as ocorrências através dos órgãos internos envolvidos e avalia a efetividade dos planos de ação propostos. Na Asset, o acompanhamento de exposição a risco operacional também é conduzido pelos Comitês Internos de Risco e pelo Comitê Setorial de Risco da WMS. Por favor referir ao Fluxo de Gestão de Riscos WMS em anexo.

A criação do Comitê Setorial de Risco em âmbito geral da WMS e de Comitês Internos de Risco em cada um de seus departamentos contribuiu para o desenvolvimento da cultura de Compliance e Controles Internos da WMS. Cabe ao Comitê Setorial de Risco o controle e acompanhamento global de risco da WMS. Cabe aos Comitês Internos de Risco o controle e acompanhamento de risco dentro de cada um dos departamentos de atuação da Área.

#### Descrição de regras e controles – Risco Legal

As questões jurídicas são tratadas por estrutura interna especializada em questões relativas ao mercado de capitais.

#### Descrição de regras e controles – Atuação de “Compliance”

A Superintendência de Controles Internos e Compliance WMS (SCIC WMS) é uma área independente das áreas de negócios, produtos e serviços, reportando-se diretamente para a Área de Controle de Riscos do



Grupo e matricialmente para a Diretoria de Gestão de Riscos da WMS, e tem entre as suas principais responsabilidades:

#### Controles Internos

- Identificação, captura e registro de eventos de riscos;
- Avaliação do ambiente e acompanhamento dos planos de ação, política específica na Itaú Asset Management para os riscos e controles priorizados, com testes e indicadores;
- Coordenação do processo de certificação das Demonstrações Financeiras para efeito da Lei Sarbanes Oxley (SOX);
- Validação dos controles para certificação de Basileia;

#### Compliance

- Canal de comunicação com órgãos reguladores no Brasil e Exterior, incluindo atendimento às fiscalizações e monitoramento de envio de informações;
- Monitoramento do ambiente regulatório e avaliação de impactos nos processos, alinhado ao Jurídico;
- Garantia da aderência às normas externas e às políticas e procedimentos internos.

#### Governança

- Coordenação dos Comitês Setoriais e Superior de Riscos e Compliance, fóruns para reporte e tomada de decisão;
- Governança de aprovação de produtos e processos;
- Cultura;
- Disseminação da cultura de controles internos e compliance na organização, por meio de programas de capacitação de conscientização;
- Apoio a áreas executivas em seus processos de auto-avaliação e priorização dos riscos.

### VIII - POLÍTICA DE TRANSPARÊNCIA

A instituição possui ferramenta eletrônica que possibilite a consulta (visualização) das operações efetuadas: saldos, aplicações, resgates, transferências e migrações, por meio da rede mundial de computadores? Qual procedimento?

O cliente necessita que as carteiras dos fundos sejam abertas diariamente nos formatos PDF, e que os extratos (conta corrente e dos investimentos), possam ser consultados. Favor informar a periodicidade para disponibilização das informações acima.

Sim, por meio do Itaú Empresas na Internet.

### IX – HISTÓRICO DA EMPRESA

A instituição financeira ou os dirigentes já foram autuados pela CVM ou pelo Banco Central pelo descumprimento de normas regulares? Algum processo de investigação? Caso positivo, informar o número do processo.

O Itaú Unibanco S.A. e seus dirigentes, ao longo do desenvolvimento de suas respectivas atividades, foram partes de processos administrativos na CVM, no BACEN e no CRSFN. Entretanto, não houve nenhuma condenação que impactasse a atividade de gestão de fundos de investimento.

Atualmente, não existe nenhum processo administrativo contra o Itaú Unibanco S.A., na qualidade de instituição gestora de fundos de investimento regulamentados pela ICVM 409/04.

Entretanto, o Itaú Unibanco S.A. e seus dirigentes, ao longo do desenvolvimento de suas respectivas atividades, foram partes de processos administrativos na CVM, no BACEN e no CRSFN. Porém, não houve nenhuma condenação que impactasse a atividade de gestão de fundos de investimento.

#### X - PRODUTOS APRESENTADOS AO RPPS

Relacionar os produtos destinados aos RPPS de acordo com a legislação vigente. Informar seus respectivos patrimônios, taxa de administração, performance (se houver) e benchmark.

Ainda com relação aos produtos, informar o desempenho dos mesmos, comparados com seus respectivos benchmarks nos últimos 24 (vinte e quatro meses), bem como o comparativo com relação a volatilidade apresentada (Risco: VaR).

1) Fundo: \_\_\_\_\_

Patrimônio do Fundo:

Benchmark (índice de referência):

Taxa de administração:

Taxa de Performance:

2) Fundo: \_\_\_\_\_

Patrimônio do Fundo:

Benchmark (índice de referência):

Taxa de administração:

Taxa de Performance:

3) Fundo: \_\_\_\_\_

Patrimônio do Fundo:

Benchmark (índice de referência):

Taxa de administração:

Taxa de Performance:

	Rentabilidade - Fundo (24 meses)	Rentabilidade - Benchmark (24 meses)	VaR Fundo	VaR Benchmark
1				
2				
3				

Grade de Fundos enviado via e-mail (anexo).


**XI - DECLARAÇÃO**

Declaro para os devidos fins e efeitos legais, que as informações acima prestadas são a expressão da verdade, exatas e inequívocas, bem como, estar em conformidades com todas as obrigações legais no âmbito Municipal, Estadual e Federal, a que está sujeita a instituição. Declaro ainda estar ciente que, o presente cadastro não implica por parte do RPPS compromisso de aplicação de recursos.

O Responsável se compromete, ainda, a atualizar as informações em caso de alterações que por ventura venham ocorrer.

13/02/2019

Instituição: Banco Itaú Unibanco S.A  
Gerente comercial: Cleber Gobby



Cleber Gobby  
Gerente Poder Público

Anexar somente documentos que passaram por alterações nos últimos 06 meses:

- a) Alterações, devidamente registradas, no Ato Constitutivo, estatuto ou contrato social, em se tratando de Sociedade Comercial, e no caso de sociedade por ações, acompanhadas da Ata arquivada da Assembléia da última eleição da Diretoria.
- b) Atualização dos Atestados de regularidade;
- c) Atualização do Rating de gestão atribuída por agência especializada;
- d) Atualização dos currículos de todos os profissionais agentes de gestão.
- h) Lâminas dos Fundos, Regulamentos atuais, carteiras abertas, bem como Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence, seção 2 - informações sobre o Fundo de Investimento.

